

# 東京短資デイリーレポート

2023/9/29

## <9月28日のマナタリーベース>

6,747,900
-----------

## <9月29日9時20分日銀オペ後の状況>

9時20分の日銀オペ	ノーオペ
日銀発表の日銀当座預金残高	5,521,200
前日の日銀当座預金残高-①	5,493,700
日銀当座預金残高増減前日比	+27,500

## <9月29日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

資金需給実績		
銀行券要因		+100
財政等要因		-4,400
資金過不足		-4,300
金融調節		
CP等買入	-6,500	+4,000
国債補完供給	+33,500	-48,400
金融調節合計		-17,400
当座預金増減-②		-21,700

## <9月29日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,472,000
準備預金残高	4,799,300
積み終了先	4,798,600
超過準備	4,794,000
非準備先残高	672,700

## <参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,882,600
今積み期間所要準備額(平均)	129,400
残り要積立額(積数)	4,400
残り要積立額(平均)	300
準備進捗率(%)	99.8
日数進捗率(%)	53.3
進捗率乖離幅	+46.5

## <10月2日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

資金需給予想		
銀行券要因		+400
財政等要因		-22,900
資金過不足		-22,500
金融調節確定分		
国債買入		+3,000
CP等買入	-200	
国債補完供給	+48,400	
金融調節合計		+51,200
当座預金増減		+28,700

## <10月2日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残550兆700億円)で 無担保コール0/Nは-0.075%~-0.050% での合いが中心か。
---

## <10月2日9時20分のオペによる日銀当座預金状況>

9時20分のオペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,545,700	+73,700
+40,000	5,540,700	+68,700
+35,000	5,535,700	+63,700
+30,000	5,530,700	+58,700
+25,000	5,525,700	+53,700
+20,000	5,520,700	+48,700
+15,000	5,515,700	+43,700
+10,000	5,510,700	+38,700
+5,000	5,505,700	+33,700
±0	5,500,700	+28,700
-5,000	5,495,700	+23,700
-10,000	5,490,700	+18,700
-15,000	5,485,700	+13,700
-20,000	5,480,700	+8,700
-25,000	5,475,700	+3,700
-30,000	5,470,700	-1,300
-35,000	5,465,700	-6,300
-40,000	5,460,700	-11,300
-45,000	5,455,700	-16,300

## <9月29日 日銀オペ入札結果>

※スペースの関係上、内容を省略する場合があります。詳細は弊社HPをご参照ください。

(10:10) 国債買入(5Y-10Y)	23/10/ 2	3,000億	応札 9,812億	落札 3,007億	最低 +0.006%	平均 +0.008%	按分 32.5%
(10:10) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/10/ 2		応札 0億	落札 0億	固定利回較差 +0.245%		
(10:10) 国債買入(固)(5Y-10Y)	23/10/ 2		応札 0億	落札 0億	固定利回較差 +0.455%		
(11:50) 国債補完供給	23/ 9/29-23/10/ 2		応札 48,608億	落札 48,608億	全取 -0.750%	平均 -0.751%	
(13:50) 国債補完供給	23/ 9/29-23/10/ 2		応札 732億	落札 732億	全取 -0.750%	平均 -0.750%	

## <9月29日 各オペ残高と内訳>

(カッコ内は先日付スタート・#印はエンドが13時同時処理)

共通担保(全店)固定金利	国債買入額(月初末)	貸出支援基金の運営として行うオペレーション	被災地金融機関支援資金供給	
9,973.1	75,193	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	
		16,708百万ドル	1,001	
9/27-10/11 8,510.	9/28(3-5Y) 4,508.	45,909	776,646	11/19-11/17 0.
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	9/28(5-10Y) 6,756.	12/ 4-12/ 4 10,258.	12/16-12/15 20,601.	2/18~ 2/16 0.
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	9/28(10-25Y) 2,010.	3/ 4~ 3/ 4 2,178.	3/18~ 3/18 41,458.	5/17~ 5/17 0.
1/10~ 1/10 20,011.	9/28(25Y-) 1,001.	6/ 3~ 6/ 3 1,950.	6/19~ 6/19 63,179.	8/19~ 8/19 381.
1/13~ 1/14 20,008.	9/28(物国) 601.	9/ 2~ 9/ 2 1,804.	9/16~ 9/13 132,310.	11/18-11/18 93.
1/16~ 1/16 20,009.	(10/ 2(5-10Y) 3,007.)	12/ 2-12/ 2 1,712.		2/17~ 2/17 346.
1/19~ 1/20 1,163.		3/ 3~ 3/ 3 6,793.		5/12~ 5/12 181.
		6/ 2~ 6/ 2 2,644.		8/18~ 8/18 0.
		9/ 1~ 9/ 1 5,024.		
			米ドル資金供給オペ	
			0百万ドル	
			9/28-10/ 5 0.	
			※直近約1年分の期落ち分を記載	
			成長基盤強化支援米ドル特別	
			16,708百万ドル	
			12/ 2-12/ 4 3,607.	
			3/ 3~ 3/ 4 2,153.	
			6/ 2~ 6/ 3 5,566.	
			9/ 5~ 9/ 5 5,382.	
			国債買現先オペ	
			0	
			国債売現先(米ドルオペ用担保)	
			0	
			国庫短期証券買入額(月初末)	
			国債売現先オペ	
			4,003	
			0	
			9/ 6 1,001.	
			9/13 1,001.	
			9/21 1,001.	
			9/27 1,000.	
			気候変動対応支援資金供給	
			62,659	
			1/30~ 1/30 28,261.	
			7/21~ 7/19 34,398.	
			国債買現先	
			0	
			被災地金融機関支援	
			1,001	
			気候変動対応支援	
			62,648	
			成長基盤強化支援	
			39,647	
			貸出増加支援	
			702,255	
			手形売出	
			0	
			新設コロナ企業金融支援	
			0	
			国債売現先	
			0	
			供給オペ合計	
			955,308	
			国債補完供給	
			49,340	
			貸出(推定)	
			0	
			国売現(米ドル担保)	
			0	
			供給額合計	
			955,308	
			吸収額合計	
			49,340	
			差し引き	
			905,968	

※成長基盤強化支援資金供給の各オペは、貸付日・返済期日が同じ場合まとめて表示しています。ETF・J-REIT買入は、買入総額と直近の買入を表示しています。共通担保・成長基盤強化支援・貸出増加支援の各資金供給オペの貸付残高は、期日前返済による減少があるため、貸付額の合計とは必ずしも一致しません。

## <9月29日のオープン市場気配レート(単位:%)>

S/N	NCD/CP現先		CPプライマリ		TBアウトライト	
	1M	0.000	1M	0.000000	3M	買気配 -0.140
1W	売気配 -0.020		2M	-----	6M	買気配 -0.130
2W	売気配 -0.020		3M	-----	1Y	買気配 -0.020
1M	売気配 -0.020					

## <9月28日のコール市場残高(単位:億円)>

	残高	増減
市場合計	237,690	+11,147
有担保	21,895	-942
無担保	215,795	+12,089

## <9月29日のコール市場レート速報と東京レポ・レート(単位:%)>

	無担保コール				有担保コール				東京レポレート	
	最低	最高	平均	前日比	最低	最高	平均	前日比	平均値	前日比
翌日物	-0.087	0.001	-0.062	+0.001				-----	-0.551	-0.292
トムネ				-----				-----	-0.135	+0.412
スポネ				-----				-----		
1週間物	-0.060	-0.037	-0.041	+0.019				-----	-0.139	+0.223
2週間物				-0.040				-----	-0.156	+0.107
3週間物				-----				-----	-0.159	+0.062
1ヶ月物	-0.010	0.030	0.014	+0.028				-----	-0.155	+0.042
3ヶ月物				-----				-----	-0.182	-0.027
6ヶ月物				-----				-----	-0.124	-0.004
1年物				-----				-----	-0.084	-0.001

本資料は情報提供を目的としてのみ作成されたものであり、お取引の最終決定は御自身の判断でなされますようお願いいたします。  
本資料に記載されている内容は、信頼できる情報源に基づき作成されたものですが、弊社はその正確性および確実性を保証するものではありません。  
非上場債券(国債、CP等)を当社が相手方となりお買付けいただく場合は、購入対価のみお支払いいただきます。  
債券は、金利水準の変化等により価格が上下し、損失が生じるおそれがあります。  
商号等：東京短資株式会社 登録金融機関 関東財務局長(登金)第524号 加入協会：日本証券業協会